

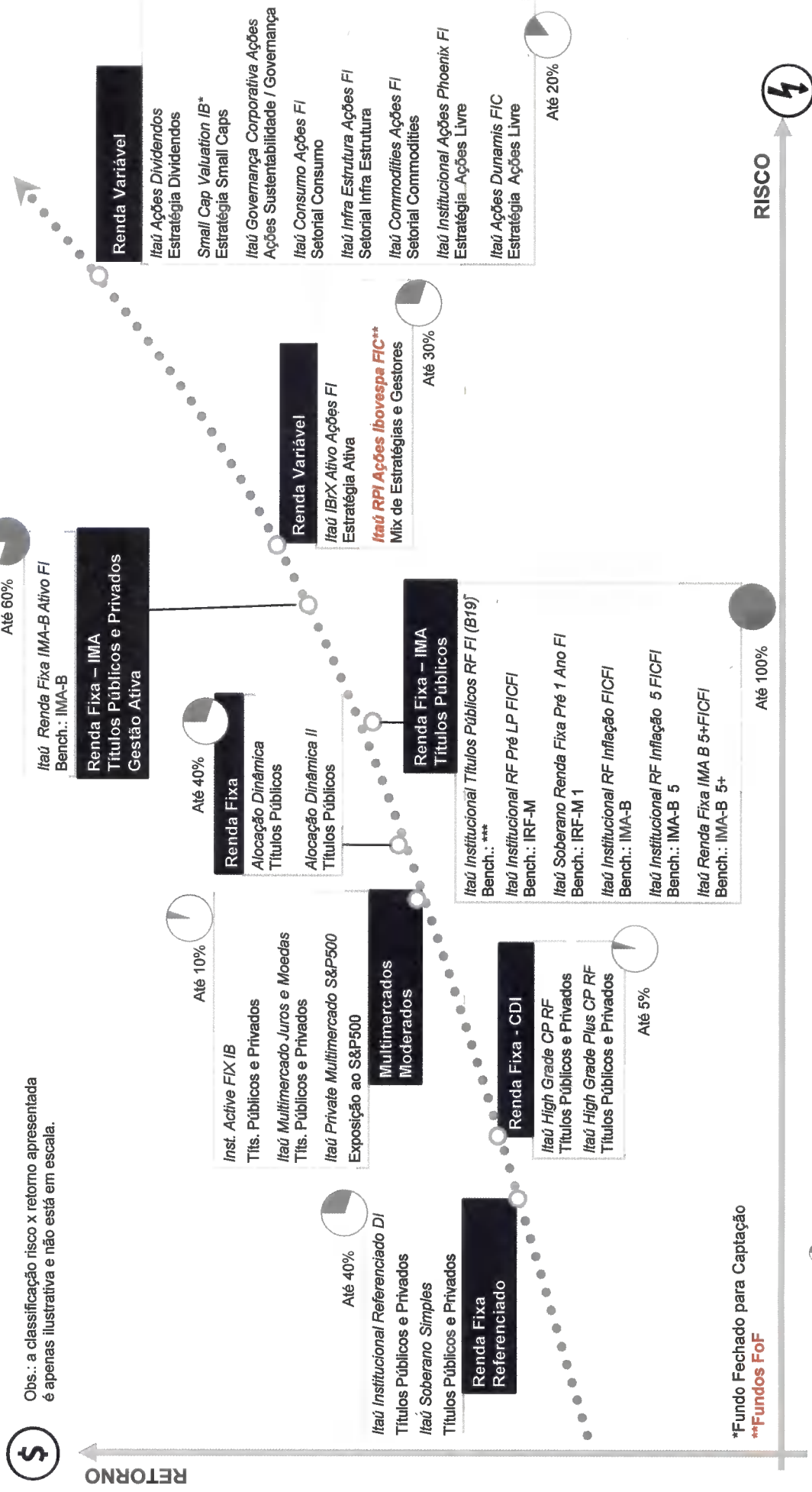
Itaú Asset Management RPPS dezembro-18



Grade de Fundos de Investimentos

Resolução CMN 4.604/2017

Obs.: a classificação risco x retorno apresentada é apenas ilustrativa e não está em escala.



*Fundo Fechado para Captação
**Fundos FoF

Fonte: Itaú Asset Management | ○ Limite de alocação conforme Resolução CMN 4.604/2017
*** Até 2 anos: IDKA 3 IPCA - Entre 2 anos e 15/05/2019: IDKA 2 IPCA - A partir de 16/05/2019: CDI



Principais Fundos de Investimentos | Renda Fixa

Mês/Ano	ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI (1, 5, e 15)		ITAÚ SOBERANO RENTA FIXA IRFM 1 FI (1, 3, 5 e 27)		ITAÚ HIGH GRADE RF CRED PRIV FICFI (1, 3, 5 e 21)		INSTITUCIONAL ACTIVE FX IB MULTIMERCADO FI (1, 3, 5, e 15)		ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FI (1, 3, 5 e 18)		ITAÚ INSTITUCIONAL RENTA FIXA PRE LP FICFI (1, 5 e 18)		ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCÇÃO DINÂMICA RF FICFI (1, 3, 5 e 15)		ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCÇÃO DINÂMICA II RF FICFI (1, 3, 5 e 15)	
	Fundo	% CDI	Fundo	# IRFM 1	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI	Fundo	% CDI	Fundo	# IRFM	Fundo	# IPCA	Fundo	# IPCA
dez/17	0,53%	97,97%	0,56%	-0,01%	0,53%	97,81%	0,55%	101,28%	0,83%	153,98%	1,22%	-0,03%	0,80%	0,36%	0,80%	0,36%
jan/18	0,57%	98,11%	0,57%	-0,03%	0,57%	98,24%	0,63%	107,91%	0,58%	100,11%	1,26%	-0,04%	1,49%	1,20%	1,49%	1,20%
fev/18	0,45%	97,42%	0,52%	-0,02%	0,45%	96,41%	0,43%	92,19%	0,48%	102,76%	1,08%	-0,03%	0,74%	0,42%	0,75%	0,43%
mar/18	0,52%	97,24%	0,64%	-0,01%	0,52%	97,61%	0,57%	106,59%	0,70%	131,47%	1,28%	-0,04%	1,03%	0,94%	1,03%	0,94%
abr/18	0,50%	97,52%	0,50%	-0,01%	0,51%	97,90%	0,49%	93,89%	0,57%	110,47%	0,43%	-0,04%	0,33%	0,11%	0,33%	0,11%
mai/18	0,51%	97,99%	0,19%	-0,01%	0,53%	102,56%	0,39%	74,62%	0,33%	63,41%	-1,89%	-0,04%	-0,35%	-0,75%	-0,34%	-0,74%
jun/18	0,51%	97,76%	0,49%	-0,05%	0,52%	101,07%	0,59%	107,85%	0,58%	111,47%	0,02%	-0,03%	0,59%	-0,67%	0,59%	-0,67%
jul/18	0,53%	97,49%	0,64%	-0,02%	0,54%	100,24%	0,59%	108,37%	0,58%	107,17%	1,43%	-0,04%	0,57%	0,24%	0,57%	0,24%
ago/18	0,56%	98,55%	0,40%	-0,04%	0,57%	100,87%	0,49%	86,50%	0,49%	85,81%	-0,97%	-0,04%	0,37%	0,46%	0,37%	0,46%
set/18	0,46%	97,82%	0,63%	0,03%	0,46%	99,15%	0,49%	105,50%	0,48%	103,37%	1,26%	-0,04%	0,42%	-0,06%	0,42%	-0,06%
out/18	0,53%	98,01%	0,89%	-0,03%	0,53%	98,07%	0,63%	116,14%	0,86%	158,06%	3,56%	-0,04%	0,51%	0,06%	0,51%	0,06%
nov/18	0,48%	97,55%	0,52%	-0,02%	0,48%	98,13%	0,38%	76,84%	0,47%	95,09%	0,95%	-0,04%	0,74%	0,95%	0,75%	0,96%
Acumulado (2018)	5,77%	97,72%	6,15%	-0,23%	5,85%	99,12%	5,78%	98,04%	6,29%	106,61%	8,63%	-0,43%	6,61%	3,02%	6,63%	3,04%
12 meses	6,33%	97,73%	6,74%	-0,25%	6,41%	99,00%	6,36%	98,31%	7,17%	110,84%	9,95%	-0,47%	7,46%	3,41%	7,48%	3,44%
24 meses	17,53%	98,76%	19,08%	-0,54%	17,75%	100,02%	17,55%	98,87%	17,21%	96,98%	26,83%	-1,11%	22,88%	15,92%	22,87%	15,91%
36 meses	34,12%	99,52%	36,20%	-1,01%	34,55%	100,77%	34,29%	100,01%	33,99%	99,13%	53,83%	-2,04%	47,60%	33,17%		
Ano 2017	9,89%	99,34%	10,89%	-0,23%	10,01%	100,54%	9,89%	99,35%	9,05%	90,97%	14,70%	-0,50%	12,87%	9,93%	12,85%	9,90%
Ano 2016	14,07%	100,50%	14,40%	-0,32%	14,20%	101,43%	14,20%	101,42%	14,31%	102,18%	22,82%	-0,55%	21,48%	15,19%	4,02%	3,54%
Ano 2015	13,38%	101,15%	12,76%	-0,25%	13,72%	103,75%	13,12%	99,21%	13,01%	98,34%	6,63%	-0,50%	5,53%	0,46%		
Limite de Investimento	40%		100%		5%		10%		10%		100%		40%		40%	
Enquadramento (Res. 4.604)	Art 7º, IV		Art 7º, I, b		Art 7º, VII, b		Art 8º, III		Art 8º, III		Art 7º, I, b		Art 7º, IV		Art 7º, IV	
Taxa de adm.	0,18% a.a.		0,20% a.a.		0,25% a.a		0,30% a.a.		0,35% a.a.		0,40% a.a.		0,40% a.a.		0,40% a.a.	
Taxa de Performance	Não há		Não há		Não há		Não há		Não há		Não há		Não há		Não há	
Cotização / Liquidação	Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D0		Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D0		Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D0		Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D0		Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D1		Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D0		Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D1		Aplic.: D0/D0 Resg.: D4/D5	
Data de Início	29/09/1995		18/10/2007		21/10/2008		12/03/2002		25/04/2000		26/11/2009		01/06/2015		14/11/2016	

Fonte: Itaú Asset Management, novembro/18

Principais Fundos de Investimentos | Renda Fixa



Mês/Ano	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 RIC (1, 3, 5 e 18)	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO FICFI (1, 3, 5 e 18)	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FICFI (1, 3, 5 e 18)	ITAÚ RENDA FIXA IMAB5+ FICFI (1, 3, 5, 18)	ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500® BRL FICFI
	Fundo # IMA-B 5	Fundo # IMA-B	Fundo # IMA-B	Fundo # IMA-B 5+	Fundo # S&P 500
dez/17	0,85% -0,03%	0,79% -0,04%	0,82% -0,01%	0,75% -0,04%	1,72% 0,73%
jan/18	1,30% -0,04%	3,36% -0,04%	3,40% 0,00%	4,90% -0,05%	5,44% -0,18%
fev/18	0,51% -0,03%	0,52% -0,03%	0,53% -0,02%	0,52% -0,04%	-3,32% 0,57%
mar/18	1,58% -0,04%	0,89% -0,05%	0,89% -0,04%	0,33% -0,05%	-2,76% -0,07%
abr/18	0,39% -0,03%	-0,17% -0,03%	-0,22% -0,07%	-0,68% -0,05%	0,57% 0,30%
mai/18	-1,59% -0,03%	-3,18% -0,03%	-3,25% -0,09%	-4,69% -0,04%	3,39% 0,53%
jun/18	0,41% -0,04%	-0,37% -0,05%	-0,29% 0,03%	-1,16% -0,08%	0,09% 0,30%
jul/18	1,44% -0,04%	2,27% -0,05%	2,31% 0,00%	3,09% -0,05%	3,85% 0,25%
ago/18	-0,29% -0,03%	-0,49% -0,04%	-0,52% -0,08%	-0,56% -0,04%	3,71% 0,68%
set/18	0,85% -0,03%	-0,18% -0,04%	-0,15% 0,00%	-1,07% -0,04%	0,47% 0,04%
out/18	3,06% -0,04%	7,08% -0,06%	7,13% -0,01%	10,59% -0,07%	-6,75% 0,19%
nov/18	0,11% -0,03%	0,82% -0,09%	0,75% -0,15%	1,48% -0,05%	1,74% -0,05%
Acumulado (2018)	7,98% -0,41%	10,67% -0,55%	10,73% -0,49%	12,65% -0,63%	5,91% 2,67%
12 meses	8,89% -0,45%	11,55% -0,60%	11,63% -0,51%	13,49% -0,68%	7,73% 3,47%
24 meses	22,73% -0,99%	27,84% -1,26%	27,89% -1,21%	30,99% -1,47%	
36 meses	42,17% -1,73%	56,62% -2,34%	57,02% -1,95%	66,46% -2,79%	
Ano 2017	12,14% -0,44%	12,28% -0,50%	12,25% -0,54%	12,16% -0,59%	27,48% 8,06%
Ano 2016	15,02% -0,46%	24,19% -0,62%	24,52% -0,29%	30,34% -0,70%	
Ano 2015	14,94% -0,51%	8,40% -0,48%	8,62% -0,26%	5,17% -0,54%	
Limite de Investimento	100%	100%	40%	100%	10%
Enquadramento (Res. 4.604)	Art 7º, I, b	Art 7º, I, b	Art 7º, IV	Art 7º, I, b	Art 8º, III
Taxa de adm.	0,40% a.a.	0,40% a.a.	0,50% a.a.	0,40% a.a.	1,00% a.a.
Taxa de Performance	Não há	Não há	Não há	Não há	Não há
Cotização / Liquidação	Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D1 03/09/2009	Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D1 26/11/2009	Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D1 28/11/2002	Aplic.: D0/D0 Resg.: D1/D2 28/03/2012	Aplic.: D0/D0 Resg.: D0/D1 31/01/2017
Data de Início					

Fonte: Itaú Asset Management, novembro/18

Principais Fundos de Investimentos | Renda Variável



Mês/Ano	ITAÚ RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FICFI (1, 5 e 29)	ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI (1, 5 e 18)	ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA AÇÕES FI (1, 5 e 18)	ITAÚ AÇÕES CONSUMO FI (1, 5 e 18)	ITAÚ AÇÕES INFRA ESTRUTURA FI (1, 5 e 18)	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI (1, 5 e 29)	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FI (1, 5 e 29)
	Fundo	Fundo	Fundo	Fundo	Fundo	Fundo	Fundo
dez/17	5,79%	5,32%	6,44%	6,79%	6,01%	5,71%	5,26%
jan/18	9,71%	12,55%	9,87%	1,46%	3,79%	7,74%	11,59%
fev/18	1,17%	0,24%	-0,28%	-3,61%	-0,70%	1,89%	0,83%
mar/18	-0,20%	1,17%	-0,51%	-0,72%	-1,16%	1,83%	0,63%
abr/18	0,45%	-1,59%	0,38%	-1,14%	1,97%	2,66%	2,96%
mai/18	-9,29%	-10,42%	-10,20%	-10,84%	-9,96%	-7,92%	-10,04%
jun/18	-4,59%	-4,09%	-4,39%	-4,62%	-3,16%	-3,07%	-3,38%
jul/18	7,10%	7,95%	8,27%	6,60%	3,40%	6,23%	5,89%
ago/18	-4,23%	-4,43%	-3,26%	-4,96%	-3,20%	-3,71%	-2,88%
set/18	1,79%	0,97%	3,35%	0,53%	-1,20%	-1,28%	3,15%
out/18	11,97%	12,49%	11,62%	4,88%	15,45%	14,23%	10,67%
nov/18	3,06%	7,03%	2,78%	1,92%	5,97%	2,89%	3,00%
Acumulado (2018)	16,03%	21,03%	16,67%	-11,11%	9,57%	21,56%	22,51%
12 meses	22,75%	27,47%	24,19%	-5,08%	16,16%	28,49%	28,96%
24 meses	44,82%	41,83%	49,58%	15,69%	36,49%	58,42%	52,66%
36 meses	86,38%	107,67%	99,34%	31,75%	60,02%	118,07%	
Ano 2017	26,70%	18,09%	30,60%	32,32%	24,29%	33,70%	27,63%
Ano 2016	29,55%	48,74%	35,47%	13,12%	21,38%	37,21%	4,58%
Ano 2015	-9,20%	-22,53%	-14,82%	-6,89%	-15,27%	-11,48%	
Limite de Investimento	30%	20%	20%	20%	20%	20%	20%
Enquadramento (Res. 4.604)	Art 8º, I	Art 8º, II, a	Art 8º, II, a	Art 8º, II, a	Art 8º, II, a	Art 8º, II, a	Art 8º, II, a
Taxa de adm.	1,50 % a.a.	1,50% a.a.	0,90% a.a.	0,90% a.a.	0,90% a.a.	2,50% a.a.	2,00 a.a.
Taxa de Performance	Não há	Não há	Não há	Não há	Não há	20% do que exceder o Ibovespa	20% do que exceder o Ibovespa
Cotização / Liquidação	Aplic.: D0/D1 Resq.: D2/D5	Aplic.: D0/D0 Resq.: D1/D4	Aplic.: D0/D0 Resq.: D1/D4	Aplic.: D0/D0 Resq.: D1/D4	Aplic.: D0/D0 Resq.: D1/D4	Aplic.: D0/D0 Resq.: D21/D24	Aplic.: D0/D0 Resq.: D21/D24
Data de Início	25/04/2008	06/01/1999	31/08/2006	20/01/2009	23/03/2007	31/10/2012	12/09/2016

Fonte: Itaú Asset Management, novembro/18

Principais Indicadores



Mês/Ano	CDI	SELIC	IMA-S	IRFIM 1	IMA - GERAL	IMA EX-C	IRF- M	IMA - B 5	IMA - B	IMA - B 5+	IMA - C	IGP-M	IPCA
dez/17	0,54%	0,54%	0,54%	0,57%	0,88%	0,89%	1,24%	0,88%	0,83%	0,79%	0,50%	0,89%	0,44%
jan/18	0,58%	0,58%	0,58%	0,59%	1,76%	1,68%	1,30%	1,33%	3,40%	4,95%	4,37%	0,76%	0,29%
fev/18	0,47%	0,47%	0,46%	0,54%	0,72%	0,72%	1,10%	0,54%	0,55%	0,56%	0,53%	0,07%	0,32%
mar/18	0,53%	0,53%	0,53%	0,66%	0,96%	0,95%	1,32%	1,62%	0,94%	0,38%	1,30%	0,64%	0,09%
abr/18	0,52%	0,52%	0,51%	0,51%	0,32%	0,30%	0,47%	0,42%	-0,14%	-0,63%	0,98%	0,57%	0,22%
mai/18	0,52%	0,52%	0,50%	0,20%	-1,43%	-1,45%	-1,85%	-1,56%	-3,16%	-4,65%	-0,47%	1,38%	0,40%
jun/18	0,52%	0,52%	0,52%	0,55%	0,12%	0,10%	0,04%	0,45%	-0,32%	-1,08%	0,69%	1,87%	1,26%
jul/18	0,54%	0,54%	0,54%	0,66%	1,41%	1,39%	1,47%	1,48%	2,32%	3,15%	2,28%	0,51%	0,33%
ago/18	0,57%	0,57%	0,57%	0,44%	-0,21%	-0,24%	-0,93%	-0,26%	-0,45%	-0,52%	0,47%	0,70%	-0,09%
set/18	0,47%	0,47%	0,47%	0,61%	0,64%	0,61%	1,30%	0,89%	-0,15%	-1,03%	1,52%	1,52%	0,48%
out/18	0,54%	0,54%	0,55%	0,92%	3,47%	3,43%	3,59%	3,10%	7,14%	10,66%	4,79%	0,89%	0,45%
nov/18	0,49%	0,49%	0,49%	0,54%	0,76%	0,78%	0,99%	0,14%	0,90%	1,52%	-0,09%	-0,49%	-0,21%
Acumulado (2018)	5,90%	5,91%	5,89%	6,38%	8,76%	8,52%	9,06%	8,39%	11,22%	13,28%	17,48%	8,71%	3,59%
12 meses	6,47%	6,48%	6,47%	6,98%	9,72%	9,48%	10,42%	9,35%	12,15%	14,17%	18,06%	9,68%	4,05%
24 meses	17,75%	17,77%	17,94%	19,62%	25,01%	24,87%	27,95%	23,72%	29,10%	32,46%	31,00%	8,73%	6,96%
36 meses	34,28%	34,33%	34,35%	37,21%	49,97%	49,84%	55,87%	43,90%	58,96%	69,25%	55,86%	16,47%	14,44%
Ano 2017	9,95%	9,97%	10,16%	11,12%	12,82%	12,89%	15,20%	12,58%	12,79%	12,75%	10,98%	-0,52%	2,95%
Ano 2016	14,00%	14,02%	13,84%	14,72%	21,00%	21,08%	23,37%	15,48%	24,81%	31,04%	18,65%	7,17%	6,29%
Ano 2015	13,23%	13,26%	13,27%	13,01%	9,32%	9,25%	7,13%	15,46%	8,88%	5,71%	10,77%	10,54%	10,67%

Fonte: Itaú Asset Management, novembro/18

Principais Indicadores



Mês/Ano	IDIV	IBOVESPA	IBX	IBX50	ISE	IGCX	S&P 500	SMLL	DOLAR
dez/17	4,94%	6,16%	6,35%	6,20%	4,91%	5,88%	0,98%	7,03%	1,42%
jan/18	9,88%	11,14%	10,74%	11,71%	7,86%	8,21%	5,62%	4,34%	-4,40%
fev/18	-0,61%	0,52%	0,42%	0,43%	-2,86%	-0,32%	-3,89%	-0,37%	2,61%
mar/18	1,05%	0,01%	0,08%	0,06%	0,71%	-1,02%	-2,69%	0,07%	2,43%
abr/18	-1,42%	0,88%	0,82%	0,63%	0,49%	0,76%	0,27%	2,37%	4,73%
mai/18	-10,53%	-10,87%	-10,91%	-10,88%	-7,95%	-10,88%	2,87%	-11,31%	7,35%
jun/18	-4,33%	-5,20%	-5,19%	-5,30%	-1,75%	-4,42%	-0,21%	-3,66%	3,18%
jul/18	7,27%	8,88%	8,84%	8,91%	3,26%	7,90%	3,60%	5,09%	-2,62%
ago/18	-3,70%	-3,21%	-3,13%	-3,08%	-1,93%	-2,54%	3,03%	-4,25%	10,13%
set/18	0,17%	3,48%	3,23%	3,73%	-1,95%	3,19%	0,43%	-1,96%	-3,18%
out/18	11,44%	10,19%	10,42%	9,71%	10,37%	10,77%	-6,94%	12,59%	-7,15%
nov/18	7,28%	2,38%	2,66%	2,15%	4,16%	2,04%	1,79%	4,79%	3,92%
Acumulado (2018)	15,21%	17,15%	16,93%	16,99%	9,47%	12,38%	3,24%	5,91%	16,79%
12 meses	20,90%	24,36%	24,35%	24,25%	14,84%	18,99%	4,25%	13,35%	18,45%
24 meses	43,07%	44,58%	45,33%	44,21%	26,68%	43,98%	25,53%	57,33%	13,74%
36 meses	122,97%	98,37%	96,14%	94,79%	42,80%	82,60%	32,67%	97,41%	0,33%
Ano 2017	25,30%	26,86%	27,55%	26,82%	17,41%	29,92%	19,42%	49,36%	1,50%
Ano 2016	60,49%	38,94%	36,70%	36,82%	13,79%	28,91%	8,79%	31,75%	-16,54%
Ano 2015	-27,45%	-13,31%	-12,41%	-13,09%	-12,88%	-11,97%	-0,05%	-22,36%	47,01%

Fonte: Itaú Asset Management, novembro/18

Informações relevantes | Renda Fixa



CNPJ	00.832.435/0001-00	ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI (1, 5, e 15)	08.703.063/0001-16	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI (1, 3, 5 e 27)	09.093.883/0001-04	ITAÚ HIGH GRADE RF CRED PRIV FICFI (1, 3, 5 e 21)	04.764.174/0001-81	INSTITUCIONAL ACTIVE FIX IB MULTIMERCADO FI (1, 3, 5, e 15)	00.973.117/0001-51	ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FI (1, 3, 5 e 18)	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA PRE LP FICFI (1, 5 e 18)
Hora de Fechamento	17:00h	Renda Fixa - Duração Baixa - Grau de Investimento	16:00h	Renda Fixa Indexados	15:30h	Renda Fixa - Duração Baixa - Grau de Investimento	17:30h	Multimercados Juros e Moedas	14:30h	Multimercados Juros e Moedas	Renda Fixa Indexados
Classificação ANBIMA											
PL Médio (12 meses) em R\$	1.174.661.711,34		275.924.295,14		2.021.851.181,54		2.146.010.308,94		74.568.576,18		264.099.679,28
PL em R\$	1.048.772.398,67		277.761.721,18		1.978.478.085,41		1.686.894.133,83		73.375.811,19		186.997.240,91
Características do Produto	Acompanhar a variação do CDI. A carteira do fundo poderá ser composta por títulos públicos e até 50% em títulos privados.	Acompanhar a variação do IRFM - 1 por meio do investimento de seus recursos em títulos públicos atrelados à taxa de juros doméstica prefixada.	Superar o CDI utilizando estratégia de gestão ativa por meio da alocação de seus recursos em títulos públicos federais e em títulos privados.	Superar o CDI. Investe em Títulos Públicos Federais e/ou privados, em derivativos referenciados e juros.	Superar o CDI. Investe em Títulos Públicos Federais e/ou privados, em derivativos referenciados, juros e câmbio.	Acompanhar a variação do IRFM. Aplica em títulos públicos atrelados à taxa de juros doméstica prefixada.					

Fonte: Itaú Asset Management, novembro/18

Informações relevantes | Renda Fixa



CNPJ	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI (1, 3, 5 e 15)	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RF FICFI (1, 3, 5 e 15)	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 FC (1, 3, 5 e 18)	ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO FICFI (1, 3, 5 e 18)	ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI (1, 3, 5 e 18)	ITAÚ RENDA FIXA IMAB5+ FICFI (1, 3, 5, 18)	ITAÚ PRIVATE MULTIMERCADO S&P500® BRL FICFI
	21.838.150/0001-49	25.306.703/0001-73	09.093.819/0001-15	10.474.513/0001-98	05.073.656/0001-58	14.437.684/0001-06	26.269.692/0001-61
Hora de Fechamento	14:00h	14:00h	15:00h	15:00h	15:00h	15:00h	14:30h
Classificação ANBIMA	Renda Fixa - Duração Livre - Crédito Livre	Renda Fixa - Duração Livre - Crédito Livre	Renda Fixa Indexados	Renda Fixa Indexados	Renda Fixa - Alta - Grau De Investimento	Renda Fixa Indexados	Multimercados Estratégia Específica
PL Médio (12 meses) em R\$	1.485.047.271,00	1.645.687.914,74	1.467.958.206,13	397.280.285,81	72.832.215,20	56.053.177,85	1.340.470.631,73
PL em R\$	1.460.666.930,50	2.413.070.507,67	1.199.197.241,91	308.727.112,40	74.007.078,28	34.939.110,87	959.500.907,47
Características do Produto	Aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados com "Renda Fixa", os quais apliquem no mínimo 80% de seus recursos em ativos financeiros de renda fixa.	Aplicar seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados com "Renda Fixa", os quais apliquem no mínimo 80% de seus recursos em ativos financeiros de renda fixa.	Esse fundo busca acompanhar a rentabilidade do índice de Mercado ANBIMA (IMA-B 5), divulgada pela ANBIMA.	Acompanhar a variação do IMA-B por meio da aplicação em títulos públicos atrelados ao indexador IPCA ou à taxa de juros doméstica.	Superar a variação do IMA-B por meio de aplicação em títulos públicos federais e/ou títulos privados atrelados ao indexador IPCA ou à taxa de juros doméstica.	Acompanhar a variação do IMAB5+ por meio da aplicação em títulos públicos atrelados ao indexador e à taxa de juros doméstica, com prazo acima de 5 anos.	O fundo tem como objetivo proporcionar retorno por meio da alocação em fundos que adotam estratégias que tenham como principal fator de risco a variação do índice S&P500®.

Fonte: Itaú Asset Management, novembro/18

Informações relevantes | Renda Variável



CNPJ	08.817.414/0001-10	ITAÚ RPI ACOES IBOVESA ATIVO FICFI (1, 5 e 29)	02.887.290/0001-62	ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA AÇÕES FI (1, 5 e 18)	10.239.877/0001-93	ITAÚ AÇÕES CONSUMO FI (1, 5 e 18)	07.658.908/0001-36	ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI (1, 5 e 29)	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC (1, 5 e 29)
Hora de Fechamento	15:00h		16:30h	16:30h	16:00h	16:00h	16:15h	16:00h	15:00h
Classificação ANBIMA	Ações Índice Ativo	Ações Dividendos	Ações	Sustentabilidade / Governança	Ações Setoriais	Ações Setoriais	Ações Setoriais	Ações Livre	Ações Livre
PL Médio (12 meses) em R\$	723.251.591,37	210.743.004,59	61.000.575,66	61.000.575,66	6.702.136,53	38.958.940,07	35.028.115,49	772.073.200,10	2.882.657,70
PL em R\$	753.683.288,80	236.556.014,45	61.879.968,14	61.879.968,14	3.793.052,76			1.367.150.526,44	9.558.190,91
Características do Produto	Investirá em cotas de fundos de investimento de gestores selecionados pela equipe de Fund of Funds. Estes fundos de investimento têm gestão ativa e como estratégia, a alocação em ações de companhias abertas, ou em derivativos.	Proporcionar retorno aos seus cotistas por meio da seleção de ações de companhias abertas que apresentem potencial de distribuição de dividendos acima da média do mercado.	Gerar retorno, no longo prazo, por meio do investimento em ações de empresas que apresentem práticas diferenciadas de governança corporativa.	Proporcionar retorno através da seleção de ações de setores da Bovespa que estejam ligados direta ou indiretamente ao consumo.	Aplicar seus recursos preponderantemente em ações de empresas dos setores da Bovespa que estejam ligados direta ou indiretamente à infraestrutura.	Proporcionar retorno aos cotistas por meio da alocação em cotas de fundos que realizam seleção de ações de companhias abertas com potencial de valorização no médio-longo prazo.	Fundo de ações de retorno absoluto, Foco em análise fundamentalista com visão internacional sobre a bolsa brasileira.		

Fonte: Itaú Asset Management, novembro/18

Informações relevantes | CADPREV



CNPJ do Gestor | Banco Itaú Unibanco S/A
60.701.190/0001-04

Nome	CNPJ do Fundo	Valor da cota	Patrimônio líquido	Benchmark	Enquadramento	Limite de alocação	Classificação	TX Adm	TX Pfee
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICF	10.474.513/0001-98	29,222297	R\$ 308.727.112,40	IMA-B	Art 7º, I, b	100%	Ativo	0,40	NA
ITAÚ INFLATION 5 RENDA FIXA FICF	09.093.819/0001-15	28,444580	R\$ 1.199.197.241,91	IMA-B5	Art 7º, I, b	100%	Ativo	0,40	NA
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B5+ FICF	14.437.684/0001-06	20,699216	R\$ 34.939.110,87	IMA-B 5+	Art 7º, I, b	100%	Ativo	0,40	NA
ITAÚ INSTITUICION RF PRE FIXADO LP FICF	10.396.381/0001-23	26,841899	R\$ 186.997.240,91	IRFM	Art 7º, I, b	100%	Passivo	0,40	NA
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA ÍNDICES PRÉ 1 FI	08.703.063/0001-16	30,464942	R\$ 277.761.721,18	IRFM 1	Art 7º, I, b	100%	Ativo	0,20	NA
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF FI	18.687.230/0001-36	11,962464	R\$ 89.548.324,98	IDKA IPCA 3 ANOS	Art 7º, I, b	100%	-	0,20	NA
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FI	05.073.656/0001-58	8,510272	R\$ 74.007.078,28	IMA-B	Art 7º, IV	40%	Ativo	0,50	NA
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA SIMPLES	06.175.696/0001-73	44,800131	R\$ 12.338.355.677,30	CDI	Art 7º, IV	40%	Passivo	0,15	NA
ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	00.832.435/0001-00	2928,571693	R\$ 1.048.772.398,67	CDI	Art 7º, IV	40%	Passivo	0,18	NA
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA	21.838.150/0001-49	15,425718	R\$ 1.460.666.930,50	IPCA	Art 7º, IV	40%	Ativo	0,40	NA
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II	25.306.703/0001-73	12,517525	R\$ 2.413.070.507,67	IPCA	Art 7º, IV	40%	Ativo	0,40	NA
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FICF	09.093.883/0001-04	27,357815	R\$ 1.978.478.085,41	CDI	Art 7º, VII, b	5%	Ativo	0,25	NA
ITAÚ HIGH GRADE PLUS RF CRÉDITO PRIVADO FICF	23.731.523/0001-03	12,813085	R\$ 692.599.657,29	CDI	Art 7º, VII, b	5%	Ativo	0,25	NA
ITAÚ INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES FI	02.228.453/0001-03			IBX 100	Art 8º, I	30%	Ativo	0,90	NA
ITAÚ RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FI	08.817.414/0001-10	2,355127	R\$ 753.683.288,80	IBOVESPA	Art 8º, I	30%	Ativo	2,50	NA
ITAÚ PRIVATE MULT S&P500 BRL FICF	26.269.692/0001-61	13,501258	R\$ 959.500.907,47	S&P 500	Art 8º, III	10%	Passivo	1,00	NA
SMALL CAP VALUATION IB FIA*	01.063.897/0001-65	101,472114	R\$ 15.916.096,84	SMLL	Art 8º, II	20%	Ativo	2,00	15%
ITAÚ GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES FI	07.686.680/0001-98	33,077930	R\$ 61.879.968,14	IGCT	Art 8º, II	20%	Ativo	0,90	NA
ITAÚ ACOES INFRA ESTRUTURA FI	07.658.908/0001-36	21,100812	R\$ 35.028.115,49	IBX 100	Art 8º, II	20%	Ativo	0,90	NA
ITAÚ ACOES COMMODITIES FI	09.093.975/0001-86	23,142221	R\$ 3.827.669,49	IBX	Art 8º, II	20%	Ativo	0,90	NA
ITAÚ ACOES DIVIDENDOS FI	02.887.290/0001-62	664,952693	R\$ 236.556.014,45	IDIV	Art 8º, II	20%	Passivo	1,50	NA
ITAÚ ACOES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO	10.239.877/0001-93	42,321214	R\$ 3.793.052,76	ICON	Art 8º, II	20%	Ativo	0,90	NA
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI	23.731.629/0001-07	20,116810	R\$ 1.367.150.526,44	IBOVESPA	Art 8º, II	20%	Ativo	2,50	20%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FC	24.571.992/0001-75	16,351775	R\$ 9.558.190,91	IBOVESPA	Art 8º, II	20%	Ativo	2,00	20%
INSTITUTIONAL ACTIVE FX IB MULTIM FI	04.764.174/0001-81	809,393837	R\$ 1.686.894.133,83	CDI	Art 8º, III	10%	Passivo	0,30	NA
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FI	00.973.117/0001-51	294,139042	R\$ 73.375.811,19	CDI	Art 8º, III	10%	Passivo	0,35	NA

Fonte: Itaú Asset Management, 12 meses| *Fundos fechados para captação

Informações relevantes | DAIR



Nome	CNPJ do Fundo	Benchmark	Enquadramento	O Fundo Possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Há ativos financeiros não emitidos por instituição Financeira?	Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registradas na CVM?	Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FDC?	Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FCFI	10.474.513/0001-98	IMA-B	Art 7º, I, b	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ INFLATION 5 RENDA FIXA FCFI	09.093.819/0001-15	IMA-B5	Art 7º, I, b	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B5+ FCFI	14.437.684/0001-06	IMA-B 5+	Art 7º, I, b	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ INSTITUCION RF PRE FIXADO LP FCFI	10.396.381/0001-23	IRFM	Art 7º, I, b	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA ÍNDICES PRÉ 1 F	08.703.063/0001-16	IRFM 1	Art 7º, I, b	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF F	18.687.230/0001-36	IDKA IPCA 3 ANOS	Art 7º, I, b	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO F	05.073.656/0001-58	IMA-B	Art 7º, IV	Sim	Sim	Sim	Não	Não	Não
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA SIMPLES	06.175.696/0001-73	CDI	Art 7º, IV	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI F	00.832.435/0001-00	CDI	Art 7º, IV	Sim	Sim	Sim	Não	Não	Não
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA	21.838.150/0001-49	IPCA	Art 7º, IV	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II	25.306.703/0001-73	IPCA	Art 7º, IV	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FCFI	09.093.883/0001-04	CDI	Art 7º, VII, b	Sim	Não	Sim	Não	Não	Não
ITAÚ HIGH GRADE PLUS RF CRÉDITO PRIVADO FCFI	23.731.523/0001-03	CDI	Art 7º, VII, b	Sim	Não	Sim	Não	Não	Não
ITAÚ INSTITUCIONAL IBRX ATIVO ACOES F	02.228.453/0001-03	IBX 100	Art 8º, I	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ RPI ACOES IBOVESPA ATIVO F	08.817.414/0001-10	IBOVESPA	Art 8º, I	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ PRIVATE MULT T S&P500 BRL FCFI	26.269.692/0001-61	S&P 500	Art 8º, III	Não	Não	Não	Não	Não	Não
SMALL CAP VALUATION IB FIA*	01.063.897/0001-65	SMLL	Art 8º, II	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ GOVERNANCA CORPORATIVA ACOES F	07.686.680/0001-98	IGCT	Art 8º, II	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ ACOES INFRA ESTRUTURA F	07.658.908/0001-36	IBX 100	Art 8º, II	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ ACOES COMMODITIES F	09.093.975/0001-86	IBX	Art 8º, II	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ ACOES DIVIDENDOS F	02.887.290/0001-62	IDIV	Art 8º, II	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ ACOES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO	10.239.877/0001-93	ICON	Art 8º, II	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX F	23.731.629/0001-07	IBOVESPA	Art 8º, II	Não	Não	Não	Não	Não	Não
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FC	24.571.992/0001-75	IBOVESPA	Art 8º, II	Não	Não	Não	Não	Não	Não
INSTITUTIONAL ACTIVE FX IB MULT-TIM F	04.764.174/0001-81	CDI	Art 8º, III	Sim	Sim	Sim	Não	Não	Não
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS F	00.973.117/0001-51	CDI	Art 8º, III	Sim	Sim	Sim	Não	Não	Não

*Fundo fechado para captação

Fonte: Itaú Asset Management, 12 meses | *Fundos fechados para captação

VaR e Volatilidade dos fundos institucionais



Nome	PL (R\$ Mil)	VaR 99% para 1 dia (R\$ Mil)	VaR 99% para 1 dia (% do PL)	Volatilidade para 1 dia (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II RF FICFI	1.834.632	10,32	0,0006%	0,0002%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	1.394.013	7,84	0,0006%	0,0002%
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FICFI	457.730	12.047,34	2,6320%	1,1314%
ITAÚ INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI	833.065	21.065,33	2,5287%	1,0870%
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FI	274.860	251,52	0,0915%	0,0393%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVSPA-ATIVO FICFI	721.543	22.756,96	3,1539%	1,3557%
ITAÚ RENDA FIXA IMAB5+ FICFI	35.179	368,47	1,0474%	0,4502%
ITAÚ RENDA FIXA IMA-B ATIVO FICFI	74.811	548,22	0,7328%	0,3150%
ITAÚ INSTITUCIONAL MULTIMERCADO JUROS E MOEDAS FI	68.515	46,88	0,0684%	0,0294%
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO FICFI	370.340	2.627,49	0,7095%	0,3050%
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLAÇÃO 5 FICFI	1.264.846	5.308,94	0,4197%	0,1804%
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA PRÉ FIXADO LP FICFI	270.114	1.319,18	0,4884%	0,2099%
ITAÚ AÇÕES CONSUMO FI	6.525	169,00	2,5900%	1,1133%
ITAÚ INVESTMENT GRADE RENDA FIXA CP FICFI	1.682.300	60,60	0,0036%	0,0015%
ITAÚ AÇÕES COMMODITIES FI	7.893	229,80	2,9115%	1,2515%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIA	14.202	395,96	2,7879%	1,1984%
INSTITUCIONAL ACTIVE FIX IB - MULTIMERCADO FI	2.011.495	692,89	0,0344%	0,0148%
ITAÚ AÇÕES INFRA ESTRUTURA FI	36.063	848,07	2,3516%	1,0109%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA AÇÕES FI	59.223	1.574,96	2,6594%	1,1432%
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP FICFI	10.373.945	58,32	0,0006%	0,0002%
ITAÚ INSTITUCIONAL IBRX-ATIVO AÇÕES FICFI	801	23,75	2,9654%	1,2747%
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	210.314	6.000,98	2,8533%	1,2265%
ITAÚ INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI - FI	896.426	2,34	0,0003%	0,0001%

Fonte: Itaú Asset Management, dados de 31/jul/18.

O modelo de VaR (Value-at-Risk) utilizado é o Paramétrico com um padrão de Intervalo de Confiança de 95%, mas em situações específicas podendo ser calculado com um Intervalo de Confiança de 99%. O Holding Period varia de acordo com o fundo.

A Volatilidade é calculada pelo modelo EWMA (Exponentially Weighted Moving Average) considerando uma janela de 252 observações e um Lambda de 0,94.

Distribuição Asset Institucional:

<p>CHRYSTIE LOMBARDI – Gerente Comercial t. 11 3631-2617 chrystie.lombardi@itau-unibanco.com.br</p>	
---	---

<p>CESAR HENRIQUES DOMINGOS – Gerente Comercial t. 11 3631-2617 cesar.domingos@itau-unibanco.com.br</p>	
--	---

<p>ANDERSON SCHEINER – Analista Comercial t. 11 3631-2541 anderson.scheiner@itau-unibanco.com.br</p>	
--	---

Poder Público:

<p>KESLLEY R. CRISPIM - Gerente t. 11 96447-1154 klesley.crispim@itau-unibanco.com.br</p>	
---	---